clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 007/11

Datum: 4. Februar 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 063/10, 100/10, 003/11

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations Hotline, Tel. +49-69-211-1 24 52,
Fax +49-69-211-1 84 40, E-Mail: risk@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- IT/System Administration

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Batch-Lauf am **7. Februar 2011** gültig.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 24 52
F +49-69-211-1 84 40
risk@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung der Margin-Parameter

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex/EEX-Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Batch-Lauf am 7. Februar 2011 gültig:

Produkt	aktueller Parameter	neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1B1	7.50	6.20
F1B2	7.50	6.20
F1B3	7.50	6.20
F1B4	7.50	6.20
F1B5	7.50	6.20
F1BM	3.70	3.70
F1BQ	2.50	2.50
F1BY	2.40	2.40
F1OM	3.20	3.20
F1OQ	2.40	2.40
F1OY	1.90	1.90
F1P1	12.40	7.80
F1P2	12.40	7.80
F1P3	12.40	7.80
F1P4	12.40	7.80
F1P5	12.40	7.80
F1PM	4.50	4.50
F1PQ	3.70	3.70
F1PY	3.40	3.40
F2CR	1.00	1.00
F2EA	1.20	1.20
F2PE	1.20	1.20
FCER	1.00	1.00
FEUA	1.10	1.10
Spread margin	**in € pro Kontrakt**	**in € pro Kontrakt**
FEUA	300	300
F2PE	300	300
FCER	300	300

Der Offset-Faktor für die Margin-Gruppe EMFO (Emissions Futures & Options) bleibt unverändert bei 25 Prozent.

4. Februar 2011